

MÉTODOS DE COMPARAÇÃO DE SÉRIES TEMPORAIS

Gladys Elena Salcedo Echeverry

Universidad del Quindio – Colombia

Clélia Maria de Castro Toloi

Departamento de Estatística, Universidade de São Paulo

Na análise de séries temporais, muitas vezes, é de interesse verificar se duas séries, ou trechos de uma mesma série, estão sendo gerados pelo mesmo processo estocástico. No caso de processos estocásticos estacionários de 2^a ordem, as hipóteses de interesse são verificar se elas apresentam igual estrutura de autocovariância (autocorrelação) ou igualdade das funções densidades espetrais.

Neste trabalho apresentamos vários testes abordados por Quenouille [*Journal Royal Statist. Soc., B* 20(1) (1958) : 158-164] , Coates e Diggle [*Journal of Time Series Analysis* , 7(1) (1986) : 7-20] , Mélard e Roy [*La Revue Cadadienne de Statistique* 12(4) (1984) : 333-342] e Carmona e Wang [*Stochastic Modelling in Physical Oceanography* 39(1) (1996) : 69-88], este último adequado para comparação de séries multivariadas.

Finalmente, fazemos uma aplicação utilizando uma série bivariada de temperatura e salinidade, medidas na superfície e no fundo da água, na estação de monitoramento denominada “Boca de Cano Grande da Ciénaga Grande de Santa Marta “ na Colombia.

Endereço para correspondência : Gladys Elena Salcedo E., Universidad del Quindio – Colombia, e-mail: gsalcedo@quimbaya.uniquindio.edu.co